



復旦大學

李彤

www.litong.tech/about

(86) 159-0083-6626 ◇ tongli19@fudan.edu.cn

1997.03.07 ◇ 男 ◇ 上海



教育经历

复旦大学

硕士 金融科技 大数据学院

2019.09-2021.06

上海

- 成绩: 3.31/4 (30%), 复旦大学优秀新生奖学金 (1w);
- 主干课程: 机器学习, 神经网络, 数据挖掘, 大数据, 量化投资, 金融风险管理, 公司金融, 金融衍生工具, 投资学。

西安交通大学

学士 金融工程 经济与金融学院

2015.09-2019.06

西安

- 成绩: 3.41/4 (30%), 思源奖学金 (1k);
- 主干课程: 量化交易, 固定收益证券, 金融工程, 宏观经济学, 微观经济学, 计量经济学, 时间序列分析, 高等数学, 会计学, 财务管理, 财政学, 国际贸易, 产业经济学, 金融大数据分析。

工作经历

嘉实基金

风险管理部业绩分析组, 量化风控助理

2020.11-2020.12

远程

- 深入研究基金组合复制的理论方法, 创造性提出基于时间卷积网络 (TCN) 和注意力机制的组合成分权重的深度学习预测模型, 解决股票基金、混合基金和指数的成分研究问题;
- 从定性和定量的角度分析股市和债市轮动效应, 基于经济增长、货币政策、流动性、市场情绪等维度对股债滚动相关性进行分析并建立指标体系, 使用时间序列模型、机器学习算法等验证了股债轮动效应的影响因素。

平安银行总行

金融交易部债券与衍生品交易团队, 交易助理

2020.07-2020.08

深圳

- 定量研究银行间资金面市场的松紧水平, 构建资金面水平展示看板, 涵盖 40+ 变量及衍生指标, 测算银行间未到期融资逐日余额; 研究银行间市场宽松程度与 AU(T+D) 中立仓方向的相关性, 基于数据可视化、时间序列分析和机器学习方法, 挖掘具有预测效果的特征; 基于格兰杰因果检验分析银行间市场券商杠杆率对于债券市场趋势的领先或滞后性。

广发基金管理有限公司

宏观策略部, 量化研究员

2019.07-2019.09

上海

- 从宏观、中观、微观等维度整理行业轮动分析框架; 从企业盈利、流动性、风险偏好三个维度研究领先市场指标, 基于理论分析、特征构建及可视化、单因子择时结果分析指标有效性, 基于等权打分方法形成市场择时策略; 基于“市场观点-估值水平”投资时钟, 进行风格指数的配置。

西安鼎松科技有限公司

投资研究部, 量化研究员

2019.03-2019.06

西安

- 优化行业因子分析框架, 包括数据管理、因子构建、时间序列和横截面回归、因子有效性检验等, 构建并研究行业内个股“因子偏离度”指标; 实践投资组合权重优化方法, 从经验方差最小化、最大夏普比率、风险中性等角度进行投资组合权重计算; 探索基于 LSTM 模型的金融时间序列预测模型。

研究经历

基于金融知识图谱的智能投资研究

毕业论文, 进行中

2020.09-至今

上海

- 部署 Scrapy 爬虫从新浪财经、上海证券网等 10+ 资讯网站进行大规模、实时金融资讯爬取;
- 基于行业板块、资金流动、投资评级等维度结构化数据构建金融知识图谱, 包括 10 余类金融主体和关系;
- 使用 FinBert、BiLSTM-CRF 等模型实现基于词典的实体识别、情感分析联合训练模型, 基于半监督方法构建大规模实体词典和情感触发词词典。
- 在 GCN、Node2Vec 基础上提出结合节点表示和新闻情感分数的舆情因子, 并进行因子有效性检验, 建立股票价格、波动率预测模型等。

专业技能

语言

大学生英语六级 (558)

Python

机器学习, 深度学习 (pytorch & tensorflow), 数据建模, 数据可视化, 网络爬虫

开发环境

MongoDB, MySQL, Neo4j, Redis, Docker, Git, LaTeX, Spark